

申万菱信中证申万证券行业指数分级证券投资基金

[2016]第四季度报告

2016年12月31日

基金管理人:申万菱信基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一七年一月二十日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事及高级管理人员不虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金托管人和基金管理人根据本基金合同所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
基金销售机构根据法律法规和基金合同的规定,对本基金的申购、赎回申请进行审查,基金份额持有人的申购、赎回申请经基金管理人确认后即有效。基金销售机构承诺,勤勉尽责地履行职责,但不保证基金一定盈利。

基金过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金报告期(2016年10月1日至2016年12月31日)止。

§ 2 基金产品概况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	7,286,316,458.08	92.06
	其中:股票	7,286,316,458.08	92.06
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
3	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	621,879,831.49	7.98
7	其他各项资产	6,056,829.55	0.08
8	合计	7,914,852,119.11	100.00

注:本基金尚未开通跨交易机制的投资于港股。

5.2 报告期末行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	-	-	-
B 采矿业	-	-	-
C 制造业	637,363.52	0.01	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,526.53	0.00	
E 建筑业	15,592.23	0.00	
F 批发和零售业	-	-	-
G 交通运输、仓储和邮政业	9,456.68	0.00	
H 餐饮和住宿业	-	-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业	241,692.20	0.00	
J 金融业	7,285,474,426.92	92.23	
K 房地产业	-	-	-
L 租赁和商务服务业	-	-	-
M 科学研究、技术服务业	-	-	-
N 水利、环境和公共设施管理业	-	-	-
O 居民服务、修理和其他服务业	-	-	-
P 教育	-	-	-
Q 卫生和社会工作	-	-	-
R 文化、体育和娱乐业	-	-	-
S 综合	-	-	-
合计	7,286,316,458.08	92.24	

5.2.2 下属分级基金的风险收益特征

5.2.3 报告期内基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率为%	净溢价率增长标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率的标准差(%)
过去三个月	-1.30%	1.12%	-0.99%	1.12%
			-0.40%	0.00%
3.2.2 本基金合同生效以来基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额对比图				

注:本基金合同生效以来基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额对比图

(2014年10月1日至2016年12月31日)

5.3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

报告期:2016年10月1日-2016年12月31日

1.本期已实现收益 -410,902,698.34

2.期初现金余额 63,194,900.74

3.期末现金余额 6,056,829.55

4.期末基金份额总额 7,914,852,119.11

5.期末可供分配基金份额总额 1,000.00

注:1.本基金已实现收益和基金本期末现金余额不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:申购费、赎回费等)。

2.上述基金业绩报酬已扣除基金管理人的管理费,但不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:申购费、赎回费等),计入认购或交易基金的各项费用后,实际收取水平将低于列示数据。

3.基金资产估值方法说明

3.2.1 报告期内基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率为%	净溢价率增长标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	业绩比较基准收益率的标准差(%)
过去三个月	-1.30%	1.12%	-0.99%	1.12%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额对比图

(2014年10月1日至2016年12月31日)

5.4 报告期内基金管理人未发生运用自有资金投资本基金情况

5.5 报告期内基金组合情况

5.6 报告期内基金投资组合情况

5.7 基金管理人未使用固有资金投资本基金情况

5.8 报告期内基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况

5.9 备查文件目录

5.10 备查文件

5.11 备查文件

5.12 备查文件

5.13 备查文件

5.14 备查文件

5.15 备查文件

5.16 备查文件

5.17 备查文件

5.18 备查文件

5.19 备查文件

5.20 备查文件

5.21 备查文件

5.22 备查文件

5.23 备查文件

5.24 备查文件

5.25 备查文件

5.26 备查文件

5.27 备查文件

5.28 备查文件

5.29 备查文件

5.30 备查文件

5.31 备查文件

5.32 备查文件

5.33 备查文件

5.34 备查文件

5.35 备查文件

5.36 备查文件

5.37 备查文件

5.38 备查文件

5.39 备查文件

5.40 备查文件

5.41 备查文件

5.42 备查文件

5.43 备查文件

5.44 备查文件

5.45 备查文件

5.46 备查文件

5.47 备查文件

5.48 备查文件

5.49 备查文件

5.50 备查文件

5.51 备查文件

5.52 备查文件

5.53 备查文件

5.54 备查文件

5.55 备查文件

5.56 备查文件

5.57 备查文件

5.58 备查文件

5.59 备查文件

5.60 备查文件

5.61 备查文件

5.62 备查文件

5.63 备查文件

5.64 备查文件

5.65 备查文件

5.66 备查文件

5.67 备查文件

5.68 备查文件

5.69 备查文件

5.70 备查文件

5.71 备查文件

5.72 备查文件

5.73 备查文件

5.74 备查文件

5.75 备查文件

5.76 备查文件

5.77 备查文件

5.78 备查文件

5.79 备查文件

5.80 备查文件

5.81 备查文件

5.82 备查文件

5.83 备查文件

5.84 备查文件

5.85 备查文件

5.86 备查文件

5.87 备查文件

5.88 备查文件

5.89 备查文件

5.90 备查文件

5.91 备查文件

5.92 备查文件

5.93 备查文件

5.94 备查文件

5.95 备查文件

5.96 备查文件

5.97 备查文件

5.98 备查文件

5.99 备查文件

5.100 备查文件

5.101 备查文件

5.102 备查文件

5.103 备查文件

5.104 备查文件